

景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式
指数证券投资基金
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|---|-----------|
| § 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| § 2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 6 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| 3.3 其他指标 | 8 |
| § 4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 10 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 11 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 11 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 12 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 12 |
| § 5 托管人报告 | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 12 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 12 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 13 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 13 |
| 6.1 资产负债表 | 13 |
| 6.2 利润表 | 14 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 | 15 |
| 6.4 报表附注 | 18 |
| § 7 投资组合报告 | 43 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 43 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 43 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 45 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 51 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 52 |

| | |
|---|-----------|
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 | 52 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 52 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 | 52 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 | 52 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 53 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 53 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 53 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 54 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 54 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人 | 54 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 54 |
| 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 | 55 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 55 |
| § 10 重大事件揭示 | 55 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 55 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 | 55 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 55 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 55 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 55 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 55 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 56 |
| 10.8 其他重大事件 | 63 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 64 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 | 64 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 64 |
| § 12 备查文件目录 | 65 |
| 12.1 备查文件目录 | 65 |
| 12.2 存放地点 | 65 |
| 12.3 查阅方式 | 65 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|-------------------------------|
| 基金名称 | 景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称 | 景顺长城中证 500 增强策略 ETF |
| 场内简称 | 500ETF 增强 |
| 基金主代码 | 159610 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 12 月 13 日 |
| 基金管理人 | 景顺长城基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 628,568,207.00 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2022 年 1 月 10 日 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数的基础上，通过主动化投资管理，力争获取超越指数表现的投资收益。 |
| 投资策略 | <p>1、股票投资策略</p> <p>本基金作为增强型的指数基金，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用主动量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。</p> <p>2、股指期货投资策略</p> <p>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。</p> <p>3、股票期权投资策略</p> <p>本基金投资股票期权将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。</p> <p>4、存托凭证投资策略</p> <p>本基金的存托凭证投资将根据本基金的投资目标和上述股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，通过定性和定量分析相结合的方式，筛选具有比较优势的存托凭证作为投资标的，以更好地实现投资目标。</p> <p>5、债券投资策略</p> <p>出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。</p> <p>6、可转换债券投资策略和可交换债券投资策略</p> <p>基金管理人根据定期公布的宏观和金融数据以及对宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，判断下一阶段的市场走势，分析可转换债券和可交换债券的股性和债性的相对价值。</p> <p>7、融资及转融通证券出借业务投资策略</p> |

| | |
|--------|--|
| | 本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。 |
| 业绩比较基准 | 中证 500 指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|-------------|------|------------------------------|---------------------|
| 名称 | | 景顺长城基金管理有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 杨皞阳 | 郭明 |
| | 联系电话 | 0755-82370388 | (010) 66105799 |
| | 电子邮箱 | investor@igwfm.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4008888606 | 95588 |
| 传真 | | 0755-22381339 | (010) 66105798 |
| 注册地址 | | 深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 办公地址 | | 深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 邮政编码 | | 518048 | 100140 |
| 法定代表人 | | 李进 | 陈四清 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券日报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.igwfm.com |
| 基金中期报告备置地点 | 基金管理人的办公场所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|----------------|------------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益 | 4,664,947.48 |
| 本期利润 | 37,303,063.60 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0556 |
| 本期加权平均净值利润率 | 6.69% |
| 本期基金份额净值增长率 | 5.71% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023 年 6 月 30 日) |

| | |
|--------------|------------------|
| 期末可供分配利润 | -109,180,049.87 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.1737 |
| 期末基金资产净值 | 520,548,519.21 |
| 期末基金份额净值 | 0.8281 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2023年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | -17.19% |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、基金份额净值的计算精确到小数点后四位，小数点后第五位四舍五入，由此产生的误差计入基金资产。

4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

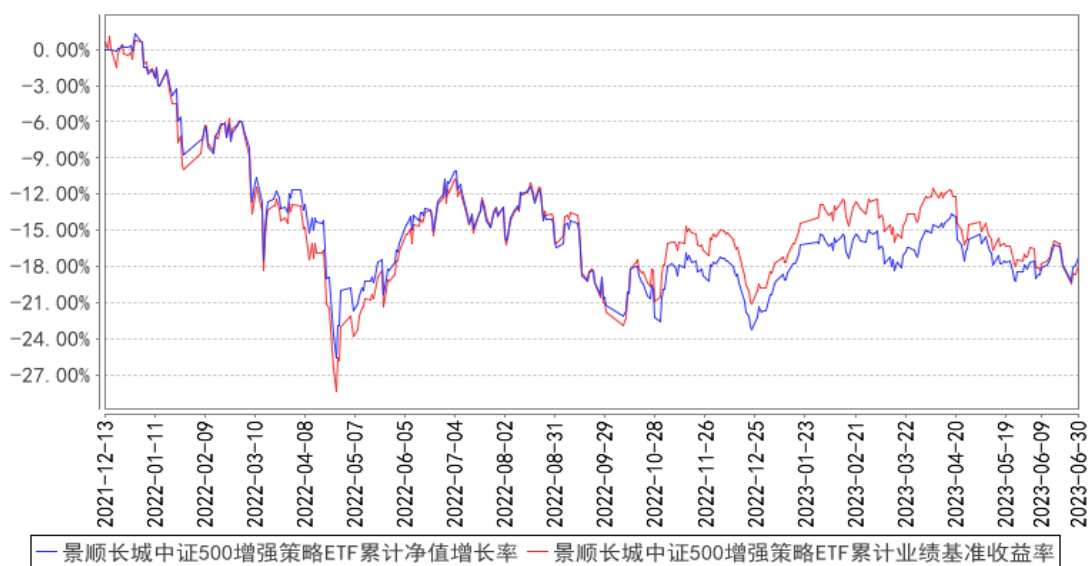
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去一个月 | 0.95% | 0.84% | -0.81% | 0.93% | 1.76% | -0.09% |
| 过去三个月 | -1.43% | 0.78% | -5.38% | 0.83% | 3.95% | -0.05% |
| 过去六个月 | 5.71% | 0.75% | 2.29% | 0.79% | 3.42% | -0.04% |
| 过去一年 | -6.94% | 0.92% | -7.06% | 0.96% | 0.12% | -0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | -17.19% | 1.13% | -17.90% | 1.20% | 0.71% | -0.07% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

景顺长城中证500增强策略ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的投资组合比例为：基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的建仓期为自 2021 年 12 月 13 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于 2003 年 6 月 9 日获得开业批文，注册资本 1.3 亿元人民币，目前，各家出资比例分别为 49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司，并设立全资子公司——景顺长城资产管理（深圳）有限公司。

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII 等业务资格，截至 2023 年 6 月 30 日，本公司旗下共管理 175 只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产配置等多个领域布局。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|------------|------------------|-----------------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 郑天行 | 本基金的基金经理 | 2023 年 1 月 10 日 | - | 9 年 | 理学硕士，CFA。曾任美国摩根斯坦利（纽约）对冲基金投资组合分析员，美国 Aristeia 基金（纽约）数据分析师，美国城堡基金（纽约）大数据研究员。2019 年 5 月加入本公司，历任养老及资产配置部研究员、ETF 投资部研究员、专户投资部投资经理，自 2022 年 8 月起担任 ETF 与创新投资部基金经理。具有 9 年证券、基金行业从业经验。 |
| 张晓南 | 本基金的基金经理 | 2021 年 12 月 13 日 | 2023 年 6 月 19 日 | 13 年 | 经济学硕士，CFA，FRM。曾任鹏华基金管理有限公司产品规划部高级产品设计师，兴银基金管理有限公司研究发展部研究员、权益投资部基金经理。2020 年 2 月加入本公司，自 2020 年 4 月起担任 ETF 与创新投资部基金经理。具有 13 年证券、基金行业从业经验。 |
| 汪洋 | 本基金的基金经理 | 2022 年 5 月 20 日 | 2023 年 6 月 19 日 | 15 年 | 理学硕士。曾任美国 KeyBank 利率衍生品部首席数量分析师，华泰联合证券股份有限公司金融工程部高级研究员，华泰柏瑞基金管理有限公司指数投资部基金经理助理，汇添富基金管理有限公司指数与量化投资部基金经理，博时基金管理有限公司指数与量化投资部副总经理兼基金经理。2021 年 10 月加入本公司，现任 ETF 与创新投资部总经理、基金经理。具有 15 年证券、基金行业从业经验。 |
| 徐喻军 | 本基金的基金经理 | 2021 年 12 月 13 日 | 2023 年 1 月 9 日 | 13 年 | 理学硕士，CFA。曾任安信证券风险管理部风险管理专员。2012 年 3 月加入本公司，担任量化及 ETF 投资部 ETF 专员，自 2014 年 4 月起担任量化及指数投资部基金经理。具有 13 年证券、基金行业从业经验。 |
| 金璜 | 本基金的基金经理助理 | 2022 年 8 月 2 日 | - | 7 年 | 工学硕士，CFA。曾任美国 Altvest Personal Wealth Management（艾福斯特个人财富管理）投资部量化研究员， |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | Morgan Stanley（美国摩根士丹利）风险管理部信用风险分析员。2018 年 7 月加入本公司，历任风险管理部经理、ETF 与创新投资部研究员，现任基金经理助理。具有 7 年证券、基金行业从业经验。 |
|--|--|--|--|--|---|

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 17 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易，按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年，A 股权益市场整体表现较为平稳但结构上有所分化，主要宽基指数涨跌幅及排序为：科创 50(4.71%)>上证指数(3.65%)>沪深 300(-0.75%)>中小 100(-1.84%)>创业板指(-5.61%)。市值维度，总体表现出小盘占优特征，规模指数涨跌幅及排序为：中证 1000(5.10%)>中证 500(2.29%)>沪深 300(-0.75%)。风格维度，中信风格指数涨跌幅及排序为：稳定(10.12%)>成长(7.80%)>周期(1.29%)>金融(-0.72%)>消费(-2.52%)。行业维度，涨跌幅排前五行业为：通信(50.66%)、传媒(42.75%)、计算机(27.57%)、机械设备(13.44%)、家用电器(13.29%)，排后五行业为：商贸零售(-23.44%)、房地产(-14.29%)、美容护理(-13.61%)、建筑材料(-10.52%)、综合(-9.62%)。

本基金采用指数增强策略进行组合管理，在严格控制跟踪误差和跟踪偏离度的基础上，力争获取相对基准指数的超额收益。在报告期内，本基金结合申购赎回情况、标的指数成分调整情况、投资策略的动态变化定期或不定期调整投资组合，保持对标的指数的紧密跟踪以及指数增强策略的实施。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2023 年上半年，本基金份额净值增长率为 5.71%，业绩比较基准收益率为 2.29%。

报告期内，本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%以内，跟踪误差（年化）控制在 6.5%以内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观数据层面，主要经济活动指标：5 月工业增加值同比增长 3.5%，前值 5.6%，经季度调整后环比增长 0.63%；5 月 PMI48.8，6 月 PMI49；5 月社会消费品零售总额同比增长 12.7%，前值 18.40%。通胀指标：5 月 PPI 同比-4.6%，前值-3.6%；5 月 CPI 当月同比 0.2%，前值 0.1%。货币金融指标：5 月 M2 同比增长 11.6%，前值 12.4%；5 月社会融资规模同比增长 9.5%，前值 10.0%。总体来看，增长斜率有所放缓，但保持良好的复苏态势，同时通胀在高基数下保持稳步回落态势。

权益市场的长期趋势反映上市公司总体盈利能力的逐步提升，背后的驱动力是经济长期增长动能以及科技升级、产业升级带来的生产力提升。目前主要宽基指数估值水平处在历史低位，在经济复苏大背景下，权益市场配置价值凸显。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等

方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持有人的合法权益。

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式报送给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，无误后返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

当发生了影响估值方法和程序的有效性及其适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

截止本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——景顺长城基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资

产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对景顺长城基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 10,162,044.14 | 7,038,551.16 |
| 结算备付金 | | 2,624,500.82 | 2,738,639.33 |
| 存出保证金 | | 97,310.05 | 123,139.74 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 512,195,189.81 | 601,312,844.55 |
| 其中：股票投资 | | 512,195,189.81 | 601,312,844.55 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 债权投资 | 6.4.7.5 | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | 6.4.7.6 | - | - |
| 其他权益工具投资 | 6.4.7.7 | - | - |
| 应收清算款 | | 234,639.46 | 2,405,318.74 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 525,313,684.28 | 613,618,493.52 |

| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|-------------|----------|------------------------|--------------------------|
| 负 债: | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | 765,209.40 | 1,775,007.00 |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 205,736.11 | 265,121.74 |
| 应付托管费 | | 41,147.20 | 53,024.35 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | 1,127.20 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 3,753,072.36 | 2,380,934.22 |
| 负债合计 | | 4,765,165.07 | 4,475,214.51 |
| 净资产: | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 628,568,207.00 | 777,568,207.00 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | -108,019,687.79 | -168,424,927.99 |
| 净资产合计 | | 520,548,519.21 | 609,143,279.01 |
| 负债和净资产总计 | | 525,313,684.28 | 613,618,493.52 |

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8281 元，基金份额总额 628,568,207.00 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|----------|--|---|
| 一、营业总收入 | | 39,161,785.33 | -135,505,925.16 |
| 1. 利息收入 | | 46,125.73 | 75,291.05 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 27,279.51 | 74,861.51 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |

| | | | |
|---------------------------------|------------|---------------|-----------------|
| 证券出借利息收入 | | 18,846.22 | 429.54 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 5,995,087.49 | -140,038,286.01 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | -1,624,942.77 | -152,631,702.62 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | 157,602.70 | 169,073.52 |
| 资产支持证券投资 收益 | 6.4.7.16 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.17 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.18 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.19 | 7,462,427.56 | 12,424,343.09 |
| 以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益 | | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列） | 6.4.7.20 | 32,638,116.12 | 2,732,958.91 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-” 号填列） | 6.4.7.21 | 482,455.99 | 1,724,110.89 |
| 减：二、营业总支出 | | 1,858,721.73 | 2,930,408.84 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 1,387,580.68 | 2,276,620.41 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 277,516.13 | 455,324.07 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产 支出 | | - | - |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.22 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 68.23 | 1.86 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.23 | 193,556.69 | 198,462.50 |
| 三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列） | | 37,303,063.60 | -138,436,334.00 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-” 号填列） | | 37,303,063.60 | -138,436,334.00 |
| 五、其他综合收益的税后 净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 37,303,063.60 | -138,436,334.00 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | | |
|--|--|--------|-----------------|-----------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产(基金净值) | 777,568,207.00 | - | -168,424,927.99 | 609,143,279.01 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产(基金净值) | 777,568,207.00 | - | -168,424,927.99 | 609,143,279.01 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -149,000,000.00 | - | 60,405,240.20 | -88,594,759.80 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 37,303,063.60 | 37,303,063.60 |
| (二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | -149,000,000.00 | - | 23,102,176.60 | -125,897,823.40 |
| 其中：1. 基金申购款 | 155,000,000.00 | - | -27,018,770.47 | 127,981,229.53 |
| 2. 基金赎回款 | -304,000,000.00 | - | 50,120,947.07 | -253,879,052.93 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | - | - | - |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产(基金净值) | 628,568,207.00 | - | -108,019,687.79 | 520,548,519.21 |
| 项目 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |

| | | 益 | | |
|--|-------------------|---|-----------------|-------------------|
| 一、上期期末净资产(基金净值) | 1,499,568,207.00 | - | 20,037,835.31 | 1,519,606,042.31 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产(基金净值) | 1,499,568,207.00 | - | 20,037,835.31 | 1,519,606,042.31 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -535,000,000.00 | - | -126,238,020.60 | -661,238,020.60 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | -138,436,334.00 | -138,436,334.00 |
| (二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | -535,000,000.00 | - | 12,198,313.40 | -522,801,686.60 |
| 其中：1. 基金申购款 | 564,000,000.00 | - | -83,640,593.18 | 480,359,406.82 |
| 2. 基金赎回款 | -1,099,000,000.00 | - | 95,838,906.58 | -1,003,161,093.42 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | - | - | - |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产(基金净值) | 964,568,207.00 | - | -106,200,185.29 | 858,368,021.71 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

基金管理人负责人

吴建军

主管会计工作负责人

邵媛媛

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]3579 号《关于准予景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式指数基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,499,494,370.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 1141 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 12 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,499,568,207.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 73,837.00 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2021]第 1362 号文审核同意,本基金 1,499,568,207.00 份基金份额于 2022 年 1 月 10 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是有效跟踪标的指数中证 500 指数的基础上,通过主动化投资管理,力争获取超越指数表现的投资收益。本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股(含存托凭证,下同),此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证)、衍生工具(股指期货、股票期权等)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、公开发行的次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可以根据有关法律法规的规定进行融资及转融通证券出借业务交易。本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例不低于 80%,投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%,因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年化跟踪误差

超过 6.5%。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2023 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有

关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前(如适用)运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起(如适用)产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通或深港通(如有)投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通或深港通(如有)买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023年6月30日 |
|-------------------|-------------------|
| 活期存款 | 10,162,044.14 |
| 等于：本金 | 10,161,435.70 |
| 加：应计利息 | 608.44 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1 个月（含）-3 个月 | - |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 10,162,044.14 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023年6月30日 | | | |
|-------------------|-------------------|------|----------------|--------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 508,510,399.79 | - | 512,195,189.81 | 3,684,790.02 |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | - | - | - |
| 资产支持证券 | - | - | - | - |
| 基金 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 508,510,399.79 | - | 512,195,189.81 | 3,684,790.02 |

注：于 2023 年 6 月 30 日，股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值 798.00 元。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末的衍生金融资产/负债余额为零。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末的其他资产余额为零。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 724,964.49 |
| 其中：交易所市场 | 724,964.49 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 293,396.69 |
| 应退替代款 | 2,722,005.18 |
| 可退替代款 | 12,706.00 |
| 合计 | 3,753,072.36 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 777,568,207.00 | 777,568,207.00 |
| 本期申购 | 155,000,000.00 | 155,000,000.00 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -304,000,000.00 | -304,000,000.00 |
| 本期末 | 628,568,207.00 | 628,568,207.00 |

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 上年度末 | -139,487,167.58 | -28,937,760.41 | -168,424,927.99 |
| 本期利润 | 4,664,947.48 | 32,638,116.12 | 37,303,063.60 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 25,642,170.23 | -2,539,993.63 | 23,102,176.60 |
| 其中：基金申购款 | -26,849,324.01 | -169,446.46 | -27,018,770.47 |
| 基金赎回款 | 52,491,494.24 | -2,370,547.17 | 50,120,947.07 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -109,180,049.87 | 1,160,362.08 | -108,019,687.79 |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|---------------------------------|
| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 活期存款利息收入 | 12,803.83 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 13,599.27 |
| 其他 | 876.41 |
| 合计 | 27,279.51 |

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -2,183,999.96 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | 559,057.19 |
| 股票投资收益——申购差价收入 | - |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | - |
| 合计 | -1,624,942.77 |

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------|---------------------------------|
| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 卖出股票成交总额 | 1,109,492,425.01 |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,109,304,000.91 |
| 减：交易费用 | 2,372,424.06 |
| 买卖股票差价收入 | -2,183,999.96 |

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 赎回基金份额对价总额 | 253,879,052.93 |
| 减：现金支付赎回款总额 | 137,004,209.93 |
| 减：赎回股票成本总额 | 116,315,785.81 |
| 减：交易费用 | - |
| 赎回差价收入 | 559,057.19 |

6.4.7.14.4 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 105.61 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 157,497.09 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 157,602.70 |

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 746,635.84 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 589,000.00 |
| 减：应计利息总额 | 108.89 |
| 减：交易费用 | 29.86 |
| 买卖债券差价收入 | 157,497.09 |

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 7,462,427.56 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | - |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 7,462,427.56 |

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 32,638,116.12 |
| 股票投资 | 32,638,116.12 |
| 债券投资 | - |
| 资产支持证券投资 | - |
| 基金投资 | - |
| 贵金属投资 | - |
| 其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| 权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | 32,638,116.12 |

注：本基金本报告期公允价值变动损益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益 798.00 元。

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | - |
| 替代损益 | 482,455.99 |
| 合计 | 482,455.99 |

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|----------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 49,588.57 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行划款手续费 | 160.00 |
| IOPV 数据费 | 9,916.99 |
| 注册登记费 | 74,383.76 |
| 合计 | 193,556.69 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|------------------------|-----------------|
| 景顺长城基金管理有限公司 | 基金管理人 |
| 中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”） | 基金托管人 |
| 长城证券股份有限公司（“长城证券”） | 基金管理人的股东、基金销售机构 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|-------|---------------------------------------|--|
|-------|---------------------------------------|--|

| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) |
|------|------|------------------|----------------|------------------|
| 长城证券 | - | - | 218,374,731.35 | 5.28 |

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | | | |
|-------|---------------------------------|----------------|----------|------------------|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总量的比例 (%) |
| 长城证券 | - | - | - | - |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日 | | | |
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总量的比例 (%) |
| 长城证券 | 203,373.59 | 9.93 | - | - |

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,387,580.68 | 2,276,620.41 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | - | - |

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|----|----------------------------|---------------------------------|
|----|----------------------------|---------------------------------|

| | 月 30 日 | 6 月 30 日 |
|----------------|------------|------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 277,516.13 | 455,324.07 |

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2023年6月30日 | | 上年度末 2022年12月31日 | |
|-------|-------------------|-----------------------------|---------------------|-----------------------------|
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%） | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%） |
| 长城证券 | 3,634,500.00 | 0.5800 | - | - |

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日 | |
|-----------|----------------------------|-----------|---------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国工商银行-活期 | 10,162,044.14 | 12,803.83 | 11,260,735.76 | 28,599.04 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------|-----|--------|-------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 受限期 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 001286 | 陕西能源 | 2023年3月31日 | 6个月 | 新股流通受限 | 9.60 | 9.41 | 3,767 | 36,163.20 | 35,447.47 | - |
| 001287 | 中电港 | 2023年3月30日 | 6个月 | 新股流通受限 | 11.88 | 21.02 | 802 | 9,527.76 | 16,858.04 | - |
| 001324 | 长青科技 | 2023年5月12日 | 6个月 | 新股流通受限 | 18.88 | 19.60 | 114 | 2,152.32 | 2,234.40 | - |
| 001328 | 登康口腔 | 2023年3月29日 | 6个月 | 新股流通受限 | 20.68 | 25.49 | 145 | 2,998.60 | 3,696.05 | - |
| 001360 | 南矿集团 | 2023年3月31日 | 6个月 | 新股流通受限 | 15.38 | 14.87 | 177 | 2,722.26 | 2,631.99 | - |
| 001367 | 海森药业 | 2023年3月30日 | 6个月 | 新股流通受限 | 44.48 | 39.48 | 55 | 2,446.40 | 2,171.40 | - |
| 001380 | 华 | 2023 | 6个月 | 新股 | 28.84 | 30.78 | 170 | 4,902.80 | 5,232.60 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-----------------|----------|--------|-------|-------|-------|------------|------------|---|
| | 纬科技 | 年 5 月 9 日 | | 流通受限 | | | | | | |
| 301141 | 中科磁业 | 2023 年 3 月 27 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 41.20 | 42.69 | 262 | 10,794.40 | 11,184.78 | - |
| 301157 | 华塑科技 | 2023 年 3 月 1 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 56.50 | 52.93 | 150 | 8,475.00 | 7,939.50 | - |
| 301202 | 朗威股份 | 2023 年 6 月 28 日 | 1 个月内(含) | 新股流通受限 | 25.82 | 25.82 | 2,754 | 71,108.28 | 71,108.28 | - |
| 301202 | 朗威股份 | 2023 年 6 月 28 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 25.82 | 25.82 | 306 | 7,900.92 | 7,900.92 | - |
| 301203 | 国泰环保 | 2023 年 3 月 28 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 46.13 | 34.40 | 225 | 10,379.25 | 7,740.00 | - |
| 301232 | 飞沃科技 | 2023 年 6 月 8 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 72.50 | 58.42 | 165 | 11,962.50 | 9,639.30 | - |
| 301246 | 宏源药业 | 2023 年 3 月 10 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 50.00 | 30.71 | 701 | 35,050.00 | 21,527.71 | - |
| 301261 | 恒工精密 | 2023 年 6 月 29 日 | 1 个月内(含) | 新股流通受限 | 36.90 | 36.90 | 1,775 | 65,497.50 | 65,497.50 | - |
| 301261 | 恒工精密 | 2023 年 6 月 29 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 36.90 | 36.90 | 198 | 7,306.20 | 7,306.20 | - |
| 301292 | 海科新源 | 2023 年 6 月 29 日 | 1 个月内(含) | 新股流通受限 | 19.99 | 19.99 | 5,241 | 104,767.59 | 104,767.59 | - |
| 301292 | 海 | 2023 | 6 个月 | 新股 | 19.99 | 19.99 | 583 | 11,654.17 | 11,654.17 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------------|-----------|--------|--------|--------|-------|-----------|-----------|-----|
| | 科新源 | 年 6 月 29 日 | | 流通受限 | | | | | | |
| 301293 | 三博脑科 | 2023 年 4 月 25 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 29.60 | 71.42 | 333 | 9,856.80 | 23,782.86 | - |
| 301301 | 川宁生物 | 2022 年 12 月 20 日 | 6 个月以上 | 新股流通受限 | 5.00 | 8.96 | 3,574 | 17,870.00 | 32,023.04 | - |
| 301307 | 美利信 | 2023 年 4 月 14 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 32.34 | 31.86 | 687 | 22,217.58 | 21,887.82 | - |
| 301315 | 威士顿 | 2023 年 6 月 13 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 32.29 | 51.12 | 226 | 7,297.54 | 11,553.12 | - |
| 301317 | 鑫磊股份 | 2023 年 1 月 12 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 20.67 | 26.17 | 694 | 14,344.98 | 18,161.98 | - |
| 301320 | 豪江智能 | 2023 年 6 月 1 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 13.06 | 20.62 | 642 | 8,384.52 | 13,238.04 | - |
| 301322 | 绿通科技 | 2023 年 2 月 27 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 131.11 | 53.24 | 193 | 25,304.23 | 10,275.32 | - |
| 301322 | 绿通科技 | 2023 年 5 月 25 日 | 1-6 个月(含) | 新股流通受限 | - | 53.24 | 96 | - | 5,111.04 | 转增股 |
| 301323 | 新莱福 | 2023 年 5 月 29 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 39.06 | 39.36 | 228 | 8,905.68 | 8,974.08 | - |
| 301325 | 曼恩斯特 | 2023 年 5 月 4 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 76.80 | 107.95 | 305 | 23,424.00 | 32,924.75 | - |
| 301332 | 德 | 2023 | 6 个月 | 新股 | 14.81 | 13.73 | 1,122 | 16,616.82 | 15,405.06 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-----------------|------|--------|-------|-------|-----|-----------|-----------|---|
| | 尔玛 | 年 5 月 9 日 | | 流通受限 | | | | | | |
| 301337 | 亚华电子 | 2023 年 5 月 16 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 32.60 | 30.37 | 232 | 7,563.20 | 7,045.84 | - |
| 301345 | 涛涛车业 | 2023 年 3 月 10 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 73.45 | 46.64 | 229 | 16,820.05 | 10,680.56 | - |
| 301355 | 南王科技 | 2023 年 6 月 2 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 17.55 | 16.75 | 563 | 9,880.65 | 9,430.25 | - |
| 301357 | 北方长龙 | 2023 年 4 月 11 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 50.00 | 48.39 | 190 | 9,500.00 | 9,194.10 | - |
| 301358 | 湖南裕能 | 2023 年 2 月 1 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 23.77 | 42.89 | 760 | 18,065.20 | 32,596.40 | - |
| 301360 | 荣旗科技 | 2023 年 4 月 17 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 71.88 | 92.60 | 134 | 9,631.92 | 12,408.40 | - |
| 301373 | 凌玮科技 | 2023 年 1 月 20 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 33.73 | 31.85 | 277 | 9,343.21 | 8,822.45 | - |
| 301386 | 未来电器 | 2023 年 3 月 21 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 29.99 | 23.79 | 378 | 11,336.22 | 8,992.62 | - |
| 301397 | 溯联股份 | 2023 年 6 月 15 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 53.27 | 40.20 | 362 | 19,283.74 | 14,552.40 | - |
| 301408 | 华人健康 | 2023 年 2 月 22 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 16.24 | 16.95 | 879 | 14,274.96 | 14,899.05 | - |
| 301419 | 阿 | 2023 | 6 个月 | 新股 | 24.80 | 43.85 | 330 | 8,184.00 | 14,470.50 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-----------------|----------|--------|-------|-------|-------|------------|------------|---|
| | 莱德 | 年 2 月 2 日 | | 流通受限 | | | | | | |
| 301428 | 世纪恒通 | 2023 年 5 月 10 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 26.35 | 30.60 | 229 | 6,034.15 | 7,007.40 | - |
| 301439 | 泓淋电力 | 2023 年 3 月 10 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 19.99 | 16.90 | 778 | 15,552.22 | 13,148.20 | - |
| 301486 | 致尚科技 | 2023 年 6 月 30 日 | 1 个月内(含) | 新股流通受限 | 57.66 | 57.66 | 3,352 | 193,276.32 | 193,276.32 | - |
| 301486 | 致尚科技 | 2023 年 6 月 30 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 57.66 | 57.66 | 373 | 21,507.18 | 21,507.18 | - |
| 601061 | 中信金属 | 2023 年 3 月 30 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 6.58 | 7.58 | 1,769 | 11,640.02 | 13,409.02 | - |
| 601065 | 江盐集团 | 2023 年 3 月 31 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 10.36 | 11.84 | 686 | 7,106.96 | 8,122.24 | - |
| 601133 | 柏诚股份 | 2023 年 3 月 31 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 11.66 | 12.26 | 633 | 7,380.78 | 7,760.58 | - |
| 603125 | 常青科技 | 2023 年 3 月 30 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 25.98 | 24.53 | 160 | 4,156.80 | 3,924.80 | - |
| 603135 | 中重科技 | 2023 年 3 月 29 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 17.80 | 17.89 | 592 | 10,537.60 | 10,590.88 | - |
| 603137 | 恒尚节能 | 2023 年 4 月 10 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 15.90 | 17.09 | 139 | 2,210.10 | 2,375.51 | - |
| 688146 | 中 | 2023 | 6 个月 | 新股 | 36.15 | 38.13 | 537 | 19,412.55 | 20,475.81 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-----------------|------|--------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| | 船特气 | 年 4 月 13 日 | | 流通受限 | | | | | | |
| 688249 | 晶合集成 | 2023 年 4 月 24 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 19.86 | 18.06 | 3,345 | 66,431.70 | 60,410.70 | - |
| 688334 | 西高院 | 2023 年 6 月 9 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 14.16 | 16.21 | 888 | 12,574.08 | 14,394.48 | - |
| 688352 | 顾中科技 | 2023 年 4 月 11 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 12.10 | 12.07 | 1,692 | 20,473.20 | 20,422.44 | - |
| 688361 | 中科飞测 | 2023 年 5 月 12 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 23.60 | 64.67 | 522 | 12,319.20 | 33,757.74 | - |
| 688429 | 时创能源 | 2023 年 6 月 20 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 19.20 | 25.53 | 346 | 6,643.20 | 8,833.38 | - |
| 688433 | 华曙高科 | 2023 年 4 月 7 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 26.66 | 31.50 | 418 | 11,143.88 | 13,167.00 | - |
| 688443 | 智翔金泰 | 2023 年 6 月 13 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 37.88 | 29.49 | 1,084 | 41,061.92 | 31,967.16 | - |
| 688458 | 美芯晟 | 2023 年 5 月 15 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 75.00 | 90.76 | 214 | 16,050.00 | 19,422.64 | - |
| 688469 | 中芯集成 | 2023 年 4 月 28 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 5.69 | 5.41 | 6,189 | 35,215.41 | 33,482.49 | - |
| 688472 | 阿特斯 | 2023 年 6 月 2 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 11.10 | 17.04 | 2,178 | 24,175.80 | 37,113.12 | - |
| 688478 | 晶 | 2023 | 6 个月 | 新股 | 32.52 | 42.37 | 402 | 13,073.04 | 17,032.74 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-----------------|----------|--------|--------|--------|-------|-----------|-----------|---|
| | 升股份 | 年 4 月 13 日 | | 流通受限 | | | | | | |
| 688479 | 友车科技 | 2023 年 5 月 4 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 33.99 | 29.49 | 332 | 11,284.68 | 9,790.68 | - |
| 688531 | 日联科技 | 2023 年 3 月 24 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 152.38 | 135.97 | 197 | 30,018.86 | 26,786.09 | - |
| 688535 | 华海诚科 | 2023 年 3 月 28 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 35.00 | 51.23 | 161 | 5,635.00 | 8,248.03 | - |
| 688543 | 国科军工 | 2023 年 6 月 14 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 43.67 | 53.05 | 372 | 16,245.24 | 19,734.60 | - |
| 688562 | 航天软件 | 2023 年 5 月 15 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 12.68 | 22.31 | 726 | 9,205.68 | 16,197.06 | - |
| 688576 | 西山科技 | 2023 年 5 月 30 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 135.80 | 120.41 | 206 | 27,974.80 | 24,804.46 | - |
| 688582 | 芯动联科 | 2023 年 6 月 21 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 26.74 | 40.68 | 573 | 15,322.02 | 23,309.64 | - |
| 688593 | 新相微 | 2023 年 5 月 25 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 11.18 | 14.59 | 959 | 10,721.62 | 13,991.81 | - |
| 688603 | 天承科技 | 2023 年 6 月 30 日 | 1 个月内(含) | 新股流通受限 | 55.00 | 55.00 | 1,251 | 68,805.00 | 68,805.00 | - |
| 688603 | 天承科技 | 2023 年 6 月 30 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 55.00 | 55.00 | 140 | 7,700.00 | 7,700.00 | - |
| 688620 | 安 | 2023 | 6 个月 | 新股 | 10.68 | 12.34 | 1,016 | 10,850.88 | 12,537.44 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-----------------|------|--------|--------|-------|-----|-----------|-----------|---|
| | 凯微 | 年 6 月 15 日 | | 流通受限 | | | | | | |
| 688623 | 双元科技 | 2023 年 5 月 31 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 125.88 | 86.79 | 154 | 19,385.52 | 13,365.66 | - |
| 688629 | 华丰科技 | 2023 年 6 月 16 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 9.26 | 18.59 | 708 | 6,556.08 | 13,161.72 | - |
| 688631 | 莱斯信息 | 2023 年 6 月 19 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 25.28 | 29.87 | 336 | 8,494.08 | 10,036.32 | - |

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量(股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|-----------------|--------|--------|----------------|--------|---------|--------------|--------------|----|
| 601298 | 青岛港 | 2023 年 6 月 28 日 | 重大事项停牌 | 6.97 | 2023 年 7 月 3 日 | 7.40 | 422,700 | 3,103,662.42 | 2,946,219.00 | - |

注：本基金截至 2023 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，

通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了以风险管理委员会为核心，由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本报告期末，本基金未持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券（上年度末：同）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不得超过该上市公司可流通股股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风

险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2023年6月30日 | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|---------------------|---------------|-------|--------|------|------|----------------|----------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 10,162,044.14 | - | - | - | - | - | 10,162,044.14 |
| 结算备付金 | 2,624,500.82 | - | - | - | - | - | 2,624,500.82 |
| 存出保证金 | 97,310.05 | - | - | - | - | - | 97,310.05 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 512,195,189.81 | 512,195,189.81 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 234,639.46 | 234,639.46 |
| 资产总计 | 12,883,855.01 | - | - | - | - | 512,429,829.27 | 525,313,684.28 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 205,736.11 | 205,736.11 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 41,147.20 | 41,147.20 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 765,209.40 | 765,209.40 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 3,753,072.36 | 3,753,072.36 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 4,765,165.07 | 4,765,165.07 |
| 利率敏感度缺口 | 12,883,855.01 | - | - | - | - | - | - |
| 上年度末 2022年12月31日 | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 7,038,551.16 | - | - | - | - | - | 7,038,551.16 |
| 结算备付金 | 2,738,639.33 | - | - | - | - | - | 2,738,639.33 |
| 存出保证金 | 123,139.74 | - | - | - | - | - | 123,139.74 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 601,312,844.55 | 601,312,844.55 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 2,405,318.74 | 2,405,318.74 |
| 资产总计 | 9,900,330.23 | - | - | - | - | 603,718,163.29 | 613,618,493.52 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 265,121.74 | 265,121.74 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 53,024.35 | 53,024.35 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 1,775,007.00 | 1,775,007.00 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 1,127.20 | 1,127.20 |

| | | | | | | | |
|---------|--------------|---|---|---|---|--------------|--------------|
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 2,380,934.22 | 2,380,934.22 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 4,475,214.51 | 4,475,214.51 |
| 利率敏感度缺口 | 9,900,330.23 | - | - | - | - | - | - |

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金未持有债券资产（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023年6月30日 | | 上年度末 2022年12月31日 | |
|---------------|-------------------|------------------|---------------------|------------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值 比例（%） | 公允价值 | 占基金资产净值 比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资 | 512,195,189.81 | 98.40 | 601,312,844.55 | 98.71 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 512,195,189.81 | 98.40 | 601,312,844.55 | 98.71 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| | | |
|----|-------------------------|-----------------------------|
| 假设 | 除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变 | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |

| | 本期末（2023 年 6 月 30 日） | 上年度末（2022 年 12 月 31 日） |
|----------------|----------------------|------------------------|
| 沪深 300 指数上升 5% | 20,938,692.72 | 20,015,557.84 |
| 沪深 300 指数下降 5% | -20,938,692.72 | -20,015,557.84 |

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | 507,657,932.89 | 599,742,356.01 |
| 第二层次 | 3,537,765.20 | - |
| 第三层次 | 999,491.72 | 1,570,488.54 |
| 合计 | 512,195,189.81 | 601,312,844.55 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2022 年 12 月

31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 512,195,189.81 | 97.50 |
| | 其中：股票 | 512,195,189.81 | 97.50 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 12,786,544.96 | 2.43 |
| 8 | 其他各项资产 | 331,949.51 | 0.06 |
| 9 | 合计 | 525,313,684.28 | 100.00 |

注：本表权益投资股票项中，含可退替代款估值增值 798.00 元，而 7.2 中不含可退替代款估值增值，因此二者存在差异。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|----------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 5,110,199.00 | 0.98 |
| B | 采矿业 | 23,590,034.00 | 4.53 |
| C | 制造业 | 253,066,145.46 | 48.62 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 16,999,512.00 | 3.27 |
| E | 建筑业 | 6,800,320.00 | 1.31 |
| F | 批发和零售业 | 12,645,183.00 | 2.43 |

| | | | |
|---|-----------------|----------------|-------|
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 12,098,384.00 | 2.32 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 25,534,778.00 | 4.91 |
| J | 金融业 | 47,172,497.60 | 9.06 |
| K | 房地产业 | 9,558,662.78 | 1.84 |
| L | 租赁和商务服务业 | 3,926,702.00 | 0.75 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,028,890.39 | 0.20 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 2,480,478.00 | 0.48 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 5,965,620.00 | 1.15 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 425,977,406.23 | 81.83 |

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 2,209,340.00 | 0.42 |
| B | 采矿业 | 2,207,850.00 | 0.42 |
| C | 制造业 | 54,374,720.88 | 10.45 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,849,415.47 | 0.36 |
| E | 建筑业 | 4,605,478.09 | 0.88 |
| F | 批发和零售业 | 1,978,140.66 | 0.38 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 2,154,128.00 | 0.41 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 4,405,975.14 | 0.85 |
| J | 金融业 | 5,909,337.00 | 1.14 |
| K | 房地产业 | 2,076,982.00 | 0.40 |
| L | 租赁和商务服务业 | 2,145,831.00 | 0.41 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 14,394.48 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共 | 7,740.00 | 0.00 |

| | | | |
|---|---------------|---------------|-------|
| | 设施管理业 | | |
| 0 | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 2,277,652.86 | 0.44 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 86,216,985.58 | 16.56 |

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|--------------|--------------|
| 1 | 300308 | 中际旭创 | 66,500 | 9,805,425.00 | 1.88 |
| 2 | 000783 | 长江证券 | 1,297,202 | 7,523,771.60 | 1.45 |
| 3 | 600516 | 方大炭素 | 1,145,854 | 7,104,294.80 | 1.36 |
| 4 | 000623 | 吉林敖东 | 427,500 | 6,857,100.00 | 1.32 |
| 5 | 600170 | 上海建工 | 2,528,000 | 6,800,320.00 | 1.31 |
| 6 | 000027 | 深圳能源 | 953,500 | 6,283,565.00 | 1.21 |
| 7 | 002422 | 科伦药业 | 204,800 | 6,078,464.00 | 1.17 |
| 8 | 601198 | 东兴证券 | 705,100 | 5,654,902.00 | 1.09 |
| 9 | 600642 | 申能股份 | 784,100 | 5,480,859.00 | 1.05 |
| 10 | 300296 | 利亚德 | 813,600 | 5,312,808.00 | 1.02 |
| 11 | 000937 | 冀中能源 | 778,600 | 4,967,468.00 | 0.95 |
| 12 | 002372 | 伟星新材 | 241,300 | 4,956,302.00 | 0.95 |
| 13 | 600066 | 宇通客车 | 336,200 | 4,955,588.00 | 0.95 |
| 14 | 002600 | 领益智造 | 711,200 | 4,914,392.00 | 0.94 |
| 15 | 000728 | 国元证券 | 738,300 | 4,813,716.00 | 0.92 |
| 16 | 002131 | 利欧股份 | 2,072,200 | 4,766,060.00 | 0.92 |
| 17 | 600271 | 航天信息 | 347,000 | 4,750,430.00 | 0.91 |
| 18 | 600161 | 天坛生物 | 173,400 | 4,707,810.00 | 0.90 |
| 19 | 601555 | 东吴证券 | 674,800 | 4,683,112.00 | 0.90 |
| 20 | 600580 | 卧龙电驱 | 317,400 | 4,637,214.00 | 0.89 |
| 21 | 601168 | 西部矿业 | 439,000 | 4,613,890.00 | 0.89 |
| 22 | 002673 | 西部证券 | 710,800 | 4,513,580.00 | 0.87 |
| 23 | 603688 | 石英股份 | 39,600 | 4,508,064.00 | 0.87 |
| 24 | 688256 | 寒武纪 | 23,437 | 4,406,156.00 | 0.85 |
| 25 | 300037 | 新宙邦 | 81,700 | 4,239,413.00 | 0.81 |
| 26 | 688390 | 固德威 | 24,461 | 4,081,562.46 | 0.78 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 27 | 600489 | 中金黄金 | 395,000 | 4,080,350.00 | 0.78 |
| 28 | 300136 | 信维通信 | 203,100 | 4,078,248.00 | 0.78 |
| 29 | 600655 | 豫园股份 | 593,900 | 4,074,154.00 | 0.78 |
| 30 | 002384 | 东山精密 | 156,000 | 4,040,400.00 | 0.78 |
| 31 | 600739 | 辽宁成大 | 293,500 | 3,859,525.00 | 0.74 |
| 32 | 300866 | 安克创新 | 44,000 | 3,850,000.00 | 0.74 |
| 33 | 002739 | 万达电影 | 307,000 | 3,849,780.00 | 0.74 |
| 34 | 601997 | 贵阳银行 | 740,800 | 3,822,528.00 | 0.73 |
| 35 | 600517 | 国网英大 | 662,400 | 3,775,680.00 | 0.73 |
| 36 | 600060 | 海信视像 | 151,200 | 3,742,200.00 | 0.72 |
| 37 | 603596 | 伯特利 | 47,100 | 3,733,146.00 | 0.72 |
| 38 | 002223 | 鱼跃医疗 | 103,100 | 3,710,569.00 | 0.71 |
| 39 | 601077 | 渝农商行 | 1,022,600 | 3,671,134.00 | 0.71 |
| 40 | 000031 | 大悦城 | 997,600 | 3,651,216.00 | 0.70 |
| 41 | 601000 | 唐山港 | 1,007,900 | 3,557,887.00 | 0.68 |
| 42 | 002409 | 雅克科技 | 48,700 | 3,549,256.00 | 0.68 |
| 43 | 688002 | 睿创微纳 | 79,066 | 3,542,156.80 | 0.68 |
| 44 | 600096 | 云天化 | 205,200 | 3,502,764.00 | 0.67 |
| 45 | 688819 | 天能股份 | 94,103 | 3,466,754.52 | 0.67 |
| 46 | 002025 | 航天电器 | 54,109 | 3,452,154.20 | 0.66 |
| 47 | 002958 | 青农商行 | 1,257,500 | 3,420,400.00 | 0.66 |
| 48 | 002531 | 天顺风能 | 224,400 | 3,417,612.00 | 0.66 |
| 49 | 300832 | 新产业 | 57,000 | 3,363,000.00 | 0.65 |
| 50 | 688072 | 拓荆科技 | 7,746 | 3,299,563.62 | 0.63 |
| 51 | 002625 | 光启技术 | 214,200 | 3,268,692.00 | 0.63 |
| 52 | 002065 | 东华软件 | 454,000 | 3,205,240.00 | 0.62 |
| 53 | 000878 | 云南铜业 | 289,200 | 3,195,660.00 | 0.61 |
| 54 | 000729 | 燕京啤酒 | 255,400 | 3,184,838.00 | 0.61 |
| 55 | 600582 | 天地科技 | 545,200 | 3,178,516.00 | 0.61 |
| 56 | 000997 | 新大陆 | 166,500 | 3,146,850.00 | 0.60 |
| 57 | 600398 | 海澜之家 | 442,500 | 3,044,400.00 | 0.58 |
| 58 | 600377 | 宁沪高速 | 308,600 | 3,033,538.00 | 0.58 |
| 59 | 601966 | 玲珑轮胎 | 136,000 | 3,021,920.00 | 0.58 |
| 60 | 601298 | 青岛港 | 422,700 | 2,946,219.00 | 0.57 |
| 61 | 603156 | 养元饮品 | 118,500 | 2,926,950.00 | 0.56 |
| 62 | 600598 | 北大荒 | 219,300 | 2,923,269.00 | 0.56 |
| 63 | 600167 | 联美控股 | 414,700 | 2,890,459.00 | 0.56 |
| 64 | 000988 | 华工科技 | 75,600 | 2,873,556.00 | 0.55 |
| 65 | 600535 | 天士力 | 197,100 | 2,859,921.00 | 0.55 |
| 66 | 600699 | 均胜电子 | 161,200 | 2,843,568.00 | 0.55 |
| 67 | 000709 | 河钢股份 | 1,241,600 | 2,806,016.00 | 0.54 |
| 68 | 600705 | 中航产融 | 725,400 | 2,778,282.00 | 0.53 |
| 69 | 600985 | 淮北矿业 | 234,900 | 2,706,048.00 | 0.52 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 70 | 000400 | 许继电气 | 117,300 | 2,703,765.00 | 0.52 |
| 71 | 002056 | 横店东磁 | 147,300 | 2,682,333.00 | 0.52 |
| 72 | 688082 | 盛美上海 | 24,244 | 2,676,537.60 | 0.51 |
| 73 | 000739 | 普洛药业 | 150,400 | 2,668,096.00 | 0.51 |
| 74 | 603228 | 景旺电子 | 103,700 | 2,659,905.00 | 0.51 |
| 75 | 002506 | 协鑫集成 | 898,700 | 2,633,191.00 | 0.51 |
| 76 | 600038 | 中直股份 | 65,100 | 2,592,282.00 | 0.50 |
| 77 | 300146 | 汤臣倍健 | 107,100 | 2,568,258.00 | 0.49 |
| 78 | 002518 | 科士达 | 64,100 | 2,564,641.00 | 0.49 |
| 79 | 002867 | 周大生 | 144,225 | 2,564,320.50 | 0.49 |
| 80 | 600350 | 山东高速 | 402,000 | 2,560,740.00 | 0.49 |
| 81 | 002244 | 滨江集团 | 287,791 | 2,538,316.62 | 0.49 |
| 82 | 600873 | 梅花生物 | 283,900 | 2,535,227.00 | 0.49 |
| 83 | 600928 | 西安银行 | 714,600 | 2,515,392.00 | 0.48 |
| 84 | 603927 | 中科软 | 64,800 | 2,498,688.00 | 0.48 |
| 85 | 600704 | 物产中大 | 505,000 | 2,494,700.00 | 0.48 |
| 86 | 002266 | 浙富控股 | 600,600 | 2,480,478.00 | 0.48 |
| 87 | 002595 | 豪迈科技 | 69,158 | 2,429,520.54 | 0.47 |
| 88 | 600021 | 上海电力 | 217,700 | 2,344,629.00 | 0.45 |
| 89 | 000933 | 神火股份 | 178,100 | 2,315,300.00 | 0.44 |
| 90 | 600329 | 达仁堂 | 51,500 | 2,311,835.00 | 0.44 |
| 91 | 002444 | 巨星科技 | 104,400 | 2,284,272.00 | 0.44 |
| 92 | 600497 | 驰宏锌锗 | 451,000 | 2,264,020.00 | 0.43 |
| 93 | 300395 | 菲利华 | 45,500 | 2,238,600.00 | 0.43 |
| 94 | 600546 | 山煤国际 | 153,200 | 2,216,804.00 | 0.43 |
| 95 | 600764 | 中国海防 | 81,200 | 2,210,264.00 | 0.42 |
| 96 | 601958 | 金钼股份 | 196,500 | 2,190,975.00 | 0.42 |
| 97 | 002299 | 圣农发展 | 114,200 | 2,186,930.00 | 0.42 |
| 98 | 600143 | 金发科技 | 249,200 | 2,175,516.00 | 0.42 |
| 99 | 000060 | 中金岭南 | 455,700 | 2,164,575.00 | 0.42 |
| 100 | 600325 | 华发股份 | 215,000 | 2,117,750.00 | 0.41 |
| 101 | 601098 | 中南传媒 | 182,400 | 2,115,840.00 | 0.41 |
| 102 | 300017 | 网宿科技 | 295,700 | 2,102,427.00 | 0.40 |
| 103 | 600481 | 双良节能 | 150,000 | 2,097,000.00 | 0.40 |
| 104 | 000630 | 铜陵有色 | 720,200 | 2,081,378.00 | 0.40 |
| 105 | 600415 | 小商品城 | 242,000 | 2,064,260.00 | 0.40 |
| 106 | 688516 | 奥特维 | 10,880 | 2,049,792.00 | 0.39 |
| 107 | 600623 | 华谊集团 | 328,800 | 2,048,424.00 | 0.39 |
| 108 | 000807 | 云铝股份 | 156,400 | 1,990,972.00 | 0.38 |
| 109 | 002373 | 千方科技 | 144,200 | 1,966,888.00 | 0.38 |
| 110 | 603218 | 日月股份 | 101,900 | 1,935,081.00 | 0.37 |
| 111 | 600801 | 华新水泥 | 154,100 | 1,903,135.00 | 0.37 |
| 112 | 603737 | 三棵树 | 28,840 | 1,886,712.80 | 0.36 |

| | | | | | |
|-----|--------|--------|---------|--------------|------|
| 113 | 000683 | 远兴能源 | 262,200 | 1,885,218.00 | 0.36 |
| 114 | 300058 | 蓝色光标 | 192,600 | 1,862,442.00 | 0.36 |
| 115 | 603000 | XD 人民网 | 63,200 | 1,845,440.00 | 0.35 |
| 116 | 688029 | 南微医学 | 22,357 | 1,823,436.92 | 0.35 |
| 117 | 002353 | 杰瑞股份 | 72,200 | 1,814,386.00 | 0.35 |
| 118 | 600418 | 江淮汽车 | 143,200 | 1,802,888.00 | 0.35 |
| 119 | 301029 | 怡合达 | 39,640 | 1,771,115.20 | 0.34 |
| 120 | 600839 | 四川长虹 | 341,900 | 1,726,595.00 | 0.33 |
| 121 | 002568 | 百润股份 | 47,400 | 1,722,990.00 | 0.33 |
| 122 | 000012 | 南玻 A | 287,600 | 1,714,096.00 | 0.33 |
| 123 | 601717 | 郑煤机 | 135,600 | 1,688,220.00 | 0.32 |
| 124 | 603338 | 浙江鼎力 | 29,600 | 1,657,896.00 | 0.32 |
| 125 | 300487 | 蓝晓科技 | 26,350 | 1,644,767.00 | 0.32 |
| 126 | 600131 | 国网信通 | 79,100 | 1,597,029.00 | 0.31 |
| 127 | 000975 | 银泰黄金 | 131,500 | 1,538,550.00 | 0.30 |
| 128 | 688281 | 华秦科技 | 7,479 | 1,514,497.50 | 0.29 |
| 129 | 002572 | 索菲亚 | 83,000 | 1,445,860.00 | 0.28 |
| 130 | 600282 | 南钢股份 | 420,100 | 1,415,737.00 | 0.27 |
| 131 | 300115 | 长盈精密 | 118,100 | 1,406,571.00 | 0.27 |
| 132 | 002532 | 天山铝业 | 231,500 | 1,386,685.00 | 0.27 |
| 133 | 600895 | 张江高科 | 89,898 | 1,251,380.16 | 0.24 |
| 134 | 600339 | 中油工程 | 301,900 | 1,228,733.00 | 0.24 |
| 135 | 688248 | 南网科技 | 26,801 | 1,028,890.39 | 0.20 |
| 136 | 600062 | 华润双鹤 | 57,400 | 999,908.00 | 0.19 |
| 137 | 603529 | 爱玛科技 | 30,050 | 968,211.00 | 0.19 |
| 138 | 603868 | 飞科电器 | 13,400 | 845,406.00 | 0.16 |

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 605598 | 上海港湾 | 50,300 | 2,648,798.00 | 0.51 |
| 2 | 600732 | 爱旭股份 | 82,260 | 2,529,495.00 | 0.49 |
| 3 | 603801 | 志邦家居 | 74,400 | 2,456,688.00 | 0.47 |
| 4 | 002044 | 美年健康 | 317,000 | 2,253,870.00 | 0.43 |
| 5 | 002254 | 泰和新材 | 91,700 | 2,243,899.00 | 0.43 |
| 6 | 688111 | 金山办公 | 4,726 | 2,231,711.72 | 0.43 |
| 7 | 600690 | 海尔智家 | 94,200 | 2,211,816.00 | 0.42 |
| 8 | 300498 | 温氏股份 | 120,400 | 2,209,340.00 | 0.42 |
| 9 | 601088 | 中国神华 | 71,800 | 2,207,850.00 | 0.42 |
| 10 | 601702 | 华峰铝业 | 161,200 | 2,205,216.00 | 0.42 |
| 11 | 000768 | 中航西飞 | 81,500 | 2,180,125.00 | 0.42 |
| 12 | 002318 | 久立特材 | 126,900 | 2,161,107.00 | 0.42 |
| 13 | 002027 | 分众传媒 | 315,100 | 2,145,831.00 | 0.41 |
| 14 | 605060 | 联德股份 | 77,700 | 2,133,642.00 | 0.41 |

| | | | | | |
|----|--------|-------|---------|--------------|------|
| 15 | 000989 | 九 芝 堂 | 153,900 | 2,129,976.00 | 0.41 |
| 16 | 603899 | 晨光股份 | 47,600 | 2,124,864.00 | 0.41 |
| 17 | 600570 | 恒生电子 | 47,700 | 2,112,633.00 | 0.41 |
| 18 | 002271 | 东方雨虹 | 77,300 | 2,107,198.00 | 0.40 |
| 19 | 600989 | 宝丰能源 | 166,600 | 2,100,826.00 | 0.40 |
| 20 | 688311 | 盟升电子 | 29,972 | 2,096,241.68 | 0.40 |
| 21 | 002436 | 兴森科技 | 135,000 | 2,092,500.00 | 0.40 |
| 22 | 001979 | 招商蛇口 | 159,400 | 2,076,982.00 | 0.40 |
| 23 | 000858 | 五 粮 液 | 12,600 | 2,060,982.00 | 0.40 |
| 24 | 002709 | 天赐材料 | 49,519 | 2,039,687.61 | 0.39 |
| 25 | 601988 | 中国银行 | 519,300 | 2,030,463.00 | 0.39 |
| 26 | 002262 | 恩华药业 | 65,472 | 2,018,501.76 | 0.39 |
| 27 | 002154 | 报 喜 鸟 | 362,400 | 2,000,448.00 | 0.38 |
| 28 | 600887 | 伊利股份 | 70,300 | 1,990,896.00 | 0.38 |
| 29 | 600958 | 东方证券 | 204,900 | 1,987,530.00 | 0.38 |
| 30 | 601390 | 中国中铁 | 256,800 | 1,946,544.00 | 0.37 |
| 31 | 688332 | 中科蓝讯 | 23,233 | 1,944,137.44 | 0.37 |
| 32 | 601607 | 上海医药 | 86,255 | 1,932,974.55 | 0.37 |
| 33 | 688110 | 东芯股份 | 53,378 | 1,926,945.80 | 0.37 |
| 34 | 601601 | 中国太保 | 72,800 | 1,891,344.00 | 0.36 |
| 35 | 300633 | 开立医疗 | 34,700 | 1,891,150.00 | 0.36 |
| 36 | 002991 | 甘源食品 | 24,200 | 1,856,140.00 | 0.36 |
| 37 | 000690 | 宝新能源 | 258,400 | 1,813,968.00 | 0.35 |
| 38 | 002332 | 仙琚制药 | 135,200 | 1,791,400.00 | 0.34 |
| 39 | 600702 | 舍得酒业 | 12,900 | 1,598,955.00 | 0.31 |
| 40 | 600026 | 中远海能 | 90,400 | 1,142,656.00 | 0.22 |
| 41 | 601882 | 海天精工 | 32,707 | 1,089,143.10 | 0.21 |
| 42 | 601021 | 春秋航空 | 17,600 | 1,011,472.00 | 0.19 |
| 43 | 301486 | 致尚科技 | 3,725 | 214,783.50 | 0.04 |
| 44 | 301292 | 海科新源 | 5,824 | 116,421.76 | 0.02 |
| 45 | 301202 | 朗威股份 | 3,060 | 79,009.20 | 0.02 |
| 46 | 688603 | 天承科技 | 1,391 | 76,505.00 | 0.01 |
| 47 | 301261 | 恒工精密 | 1,973 | 72,803.70 | 0.01 |
| 48 | 688249 | 晶合集成 | 3,345 | 60,410.70 | 0.01 |
| 49 | 688472 | 阿特斯 | 2,178 | 37,113.12 | 0.01 |
| 50 | 001286 | 陕西能源 | 3,767 | 35,447.47 | 0.01 |
| 51 | 688361 | 中科飞测 | 522 | 33,757.74 | 0.01 |
| 52 | 688469 | 中芯集成 | 6,189 | 33,482.49 | 0.01 |
| 53 | 301325 | 曼恩斯特 | 305 | 32,924.75 | 0.01 |
| 54 | 301358 | 湖南裕能 | 760 | 32,596.40 | 0.01 |
| 55 | 301301 | 川宁生物 | 3,574 | 32,023.04 | 0.01 |
| 56 | 688443 | 智翔金泰 | 1,084 | 31,967.16 | 0.01 |
| 57 | 688531 | 日联科技 | 197 | 26,786.09 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 58 | 688576 | 西山科技 | 206 | 24,804.46 | 0.00 |
| 59 | 301293 | 三博脑科 | 333 | 23,782.86 | 0.00 |
| 60 | 688582 | 芯动联科 | 573 | 23,309.64 | 0.00 |
| 61 | 301307 | 美利信 | 687 | 21,887.82 | 0.00 |
| 62 | 301246 | 宏源药业 | 701 | 21,527.71 | 0.00 |
| 63 | 688146 | 中船特气 | 537 | 20,475.81 | 0.00 |
| 64 | 688352 | 颀中科技 | 1,692 | 20,422.44 | 0.00 |
| 65 | 688543 | 国科军工 | 372 | 19,734.60 | 0.00 |
| 66 | 688458 | 美芯晟 | 214 | 19,422.64 | 0.00 |
| 67 | 301317 | 鑫磊股份 | 694 | 18,161.98 | 0.00 |
| 68 | 688478 | 晶升股份 | 402 | 17,032.74 | 0.00 |
| 69 | 001287 | 中电港 | 802 | 16,858.04 | 0.00 |
| 70 | 688562 | 航天软件 | 726 | 16,197.06 | 0.00 |
| 71 | 301332 | 德尔玛 | 1,122 | 15,405.06 | 0.00 |
| 72 | 301322 | 绿通科技 | 289 | 15,386.36 | 0.00 |
| 73 | 301408 | 华人健康 | 879 | 14,899.05 | 0.00 |
| 74 | 301397 | 溯联股份 | 362 | 14,552.40 | 0.00 |
| 75 | 301419 | 阿莱德 | 330 | 14,470.50 | 0.00 |
| 76 | 688334 | 西高院 | 888 | 14,394.48 | 0.00 |
| 77 | 688593 | 新相微 | 959 | 13,991.81 | 0.00 |
| 78 | 601061 | 中信金属 | 1,769 | 13,409.02 | 0.00 |
| 79 | 688623 | 二元科技 | 154 | 13,365.66 | 0.00 |
| 80 | 301320 | 豪江智能 | 642 | 13,238.04 | 0.00 |
| 81 | 688433 | 华曙高科 | 418 | 13,167.00 | 0.00 |
| 82 | 688629 | 华丰科技 | 708 | 13,161.72 | 0.00 |
| 83 | 301439 | 泓淋电力 | 778 | 13,148.20 | 0.00 |
| 84 | 688620 | 安凯微 | 1,016 | 12,537.44 | 0.00 |
| 85 | 301360 | 荣旗科技 | 134 | 12,408.40 | 0.00 |
| 86 | 301315 | 威士顿 | 226 | 11,553.12 | 0.00 |
| 87 | 301141 | 中科磁业 | 262 | 11,184.78 | 0.00 |
| 88 | 301345 | 涛涛车业 | 229 | 10,680.56 | 0.00 |
| 89 | 603135 | 中重科技 | 592 | 10,590.88 | 0.00 |
| 90 | 688631 | 莱斯信息 | 336 | 10,036.32 | 0.00 |
| 91 | 688479 | 友车科技 | 332 | 9,790.68 | 0.00 |
| 92 | 301232 | 飞沃科技 | 165 | 9,639.30 | 0.00 |
| 93 | 301355 | 南王科技 | 563 | 9,430.25 | 0.00 |
| 94 | 301357 | 北方长龙 | 190 | 9,194.10 | 0.00 |
| 95 | 301386 | 未来电器 | 378 | 8,992.62 | 0.00 |
| 96 | 301323 | 新莱福 | 228 | 8,974.08 | 0.00 |
| 97 | 688429 | 时创能源 | 346 | 8,833.38 | 0.00 |
| 98 | 301373 | 凌玮科技 | 277 | 8,822.45 | 0.00 |
| 99 | 688535 | 华海诚科 | 161 | 8,248.03 | 0.00 |
| 100 | 601065 | 江盐集团 | 686 | 8,122.24 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 101 | 301157 | 华塑科技 | 150 | 7,939.50 | 0.00 |
| 102 | 601133 | 柏诚股份 | 633 | 7,760.58 | 0.00 |
| 103 | 301203 | 国泰环保 | 225 | 7,740.00 | 0.00 |
| 104 | 301337 | 亚华电子 | 232 | 7,045.84 | 0.00 |
| 105 | 301428 | 世纪恒通 | 229 | 7,007.40 | 0.00 |
| 106 | 001380 | 华纬科技 | 170 | 5,232.60 | 0.00 |
| 107 | 603125 | 常青科技 | 160 | 3,924.80 | 0.00 |
| 108 | 001328 | 登康口腔 | 145 | 3,696.05 | 0.00 |
| 109 | 001360 | 南矿集团 | 177 | 2,631.99 | 0.00 |
| 110 | 603137 | 恒尚节能 | 139 | 2,375.51 | 0.00 |
| 111 | 001324 | 长青科技 | 114 | 2,234.40 | 0.00 |
| 112 | 001367 | 海森药业 | 55 | 2,171.40 | 0.00 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1 | 601077 | 渝农商行 | 13,844,761.00 | 2.27 |
| 2 | 000783 | 长江证券 | 10,693,689.92 | 1.76 |
| 3 | 600516 | 方大炭素 | 10,416,581.92 | 1.71 |
| 4 | 601555 | 东吴证券 | 9,546,521.00 | 1.57 |
| 5 | 600489 | 中金黄金 | 8,305,118.00 | 1.36 |
| 6 | 600862 | 中航高科 | 8,108,126.00 | 1.33 |
| 7 | 000027 | 深圳能源 | 8,107,034.00 | 1.33 |
| 8 | 601168 | 西部矿业 | 7,778,654.00 | 1.28 |
| 9 | 600170 | 上海建工 | 7,636,671.00 | 1.25 |
| 10 | 600022 | 山东钢铁 | 7,579,131.00 | 1.24 |
| 11 | 000898 | 鞍钢股份 | 7,385,529.00 | 1.21 |
| 12 | 601198 | 东兴证券 | 7,199,393.00 | 1.18 |
| 13 | 000623 | 吉林敖东 | 7,175,966.00 | 1.18 |
| 14 | 600642 | 申能股份 | 6,912,543.00 | 1.13 |
| 15 | 600580 | 卧龙电驱 | 6,874,116.00 | 1.13 |
| 16 | 600728 | 佳都科技 | 6,787,267.00 | 1.11 |
| 17 | 000987 | 越秀资本 | 6,637,511.25 | 1.09 |
| 18 | 600655 | 豫园股份 | 6,581,935.00 | 1.08 |
| 19 | 000988 | 华工科技 | 6,397,852.00 | 1.05 |
| 20 | 600985 | 淮北矿业 | 6,323,473.35 | 1.04 |

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|------|------|----------|----------------|
|----|------|------|----------|----------------|

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 1 | 600008 | 首创环保 | 11,360,424.80 | 1.86 |
| 2 | 601298 | 青岛港 | 11,257,512.93 | 1.85 |
| 3 | 601077 | 渝农商行 | 10,628,373.00 | 1.74 |
| 4 | 600901 | 江苏金租 | 10,481,607.00 | 1.72 |
| 5 | 600820 | 隧道股份 | 9,757,111.00 | 1.60 |
| 6 | 600871 | 石化油服 | 9,704,239.00 | 1.59 |
| 7 | 600208 | 新湖中宝 | 9,396,916.66 | 1.54 |
| 8 | 600895 | 张江高科 | 9,173,833.36 | 1.51 |
| 9 | 688063 | 派能科技 | 9,129,428.32 | 1.50 |
| 10 | 600598 | 北大荒 | 9,080,152.52 | 1.49 |
| 11 | 600873 | 梅花生物 | 9,063,887.93 | 1.49 |
| 12 | 600863 | 内蒙华电 | 8,778,593.00 | 1.44 |
| 13 | 600998 | 九州通 | 8,383,793.00 | 1.38 |
| 14 | 600967 | 内蒙一机 | 8,370,804.00 | 1.37 |
| 15 | 600862 | 中航高科 | 8,142,677.00 | 1.34 |
| 16 | 000750 | 国海证券 | 8,041,412.80 | 1.32 |
| 17 | 300017 | 网宿科技 | 8,016,622.00 | 1.32 |
| 18 | 300009 | 安科生物 | 7,808,877.04 | 1.28 |
| 19 | 601598 | 中国外运 | 7,708,049.44 | 1.27 |
| 20 | 600160 | 巨化股份 | 7,676,788.18 | 1.26 |

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 1,046,647,875.57 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,109,492,425.01 |

注：买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均为买卖股票成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|-------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 97,310.05 |
| 2 | 应收清算款 | 234,639.46 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 331,949.51 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人 户数 (户) | 户均持有的 基金份 额 | 持有人结构 | | | | | |
|------------------|-------------------|----------------|-----------------------|----------------|-----------------------|------|-------------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | | - | |
| | | 持有份额 | 占总 份额 比例 (%) | 持有份额 | 占总 份额 比例 (%) | 持有份额 | 占总份 额比例 (%) |
| 10,368 | 60,625.79 | 100,660,852.00 | 16.01 | 527,907,355.00 | 83.99 | - | - |

8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额 (份) | 占上市总份额比例 (%) |
|----|--|---------------|--------------|
| 1 | 招商证券股份有限公司 | 27,062,512.00 | 4.31 |
| 2 | 邹明刚 | 14,991,100.00 | 2.38 |
| 3 | 浙江瓊尔德投资管理 有限公司—瓊尔德润 鑫 10 号私募证券投资 基金 | 13,500,000.00 | 2.15 |
| 4 | 沈文荣 | 11,184,217.00 | 1.78 |
| 5 | 方正证券股份有限公司 | 9,573,652.00 | 1.52 |
| 6 | 郑州尚之康建材有限 公司 | 8,600,700.00 | 1.37 |
| 7 | 中信建投证券股份有 限公司 | 8,327,723.00 | 1.32 |
| 8 | 刘英 | 3,756,351.00 | 0.60 |
| 9 | 长城证券股份有限公 司 | 3,634,500.00 | 0.58 |
| 10 | 倪德良 | 3,400,023.00 | 0.54 |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末基金管理人的所有从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

- 1、本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本期末本基金的基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|-------------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2021 年 12 月 13 日） 基金份额总额 | 1,499,568,207.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 777,568,207.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 155,000,000.00 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 304,000,000.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 628,568,207.00 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期末未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|----------------|--------|------------------|------------------|--------------|----------------|------|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | |
| 招商证券股份有限公司 | 4 | 2,136,441,151.57 | 99.59 | 1,081,265.83 | 99.25 | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | 2 | 8,727,041.75 | 0.41 | 8,127.45 | 0.75 | - |
| 安信证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长城证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 第一创业证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方财富证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东方证券股份有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 东亚前海证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 高盛(中国)证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券股份有限 | 2 | - | - | - | - | 本期报告 |

| | | | | | | | |
|----------------------|---|---|---|---|---|---|-----------------------|
| 公司 | | | | | | | 新增 2 个 |
| 广发证券 股份有限 公司 | 2 | - | - | - | - | - | - |
| 国都证券 股份有限 公司 | 2 | - | - | - | - | - | 本期 报告 新增 1 个 |
| 国海证券 股份有限 公司 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 股份有限 公司 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 有限责任 公司 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 证券股份 有限公司 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 股份有限 公司 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券 股份有限 公司 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 有限责任 公司 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 华西证券 股份有限 公司 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 开源证券 股份有限 公司 | 2 | - | - | - | - | - | 本期 报告 新增 2 个 |
| 民生证券 股份有限 公司 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券 股份有限 公司 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞信证券 | 2 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | |
|--------------|---|---|---|---|---|---|------------|
| (中国)有限公司 | | | | | | | |
| 瑞银证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 申港证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券有限公司 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 中国国际金融股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 中航证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 3 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 中邮证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - | 本期报告新增 1 个 |

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

- a、资金实力雄厚，信誉良好；
- b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- c、经营行为规范，最近三年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；
- d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；
- e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

2) 选择程序

基金管理人根据以上标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|--------------|------------|-----------------|--------|-------------------|------|-----------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例(%) |
| 招商证券股份有限公司 | 746,635.84 | 100.00 | - | - | - | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 第一创业证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|----------------------------|---|---|---|---|---|---|
| 东方财 富证券 股份有 限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证 券股份 有限公 司 | - | - | - | - | - | - |
| 东亚前 海证券 有限责 任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证 券股份 有限公 司 | - | - | - | - | - | - |
| 高盛(中 国)证券 有限责 任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证 券股份 有限公 司 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证 券股份 有限公 司 | - | - | - | - | - | - |
| 国都证 券股份 有限公 司 | - | - | - | - | - | - |
| 国海证 券股份 有限公 司 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证 券股份 有限公 司 | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证 券有限 责任公 司 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|--------------|---|---|---|---|---|---|
| 国泰君安证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华西证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 开源证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞信证券(中国)有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 申港证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|--------------|---|---|---|---|---|---|
| 申万宏源证券有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国国际金融股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中航证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中邮证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---|--------------|-----------------|
| 1 | 景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 1 月 10 日 |
| 2 | 景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 1 号更新招募说明书 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 1 月 12 日 |
| 3 | 景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 1 月 12 日 |
| 4 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 1 月 20 日 |
| 5 | 景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 4 季度报告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 1 月 20 日 |
| 6 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 2 月 10 日 |
| 7 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华安证券为一级交易商的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 2 月 22 日 |
| 8 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中金财富证券为一级交易商的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 2 月 24 日 |
| 9 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 2 月 24 日 |
| 10 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 3 月 25 日 |
| 11 | 景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2022 年年度报告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 3 月 28 日 |
| 12 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年年度报告提示性公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 3 月 28 日 |
| 13 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东海证券为一级交易商的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 3 日 |
| 14 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 8 日 |
| 15 | 景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 18 日 |
| 16 | 景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 1 季度报告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 21 日 |
| 17 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下 | 中国证监会指定报刊及 | 2023 年 4 月 21 日 |

| | | | |
|----|---|--------------|-----------------|
| | 基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告 | 网站 | |
| 18 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 22 日 |
| 19 | 关于景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金新增东海证券股份有限公司为流动性服务商的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 4 月 28 日 |
| 20 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 5 月 6 日 |
| 21 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 5 月 13 日 |
| 22 | 景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 2 号更新招募说明书 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 5 月 26 日 |
| 23 | 景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 5 月 26 日 |
| 24 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 5 月 27 日 |
| 25 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 6 月 10 日 |
| 26 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 6 月 17 日 |
| 27 | 景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 6 月 20 日 |
| 28 | 景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 3 号更新招募说明书 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 6 月 22 日 |
| 29 | 景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 6 月 22 日 |
| 30 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2023 年 6 月 22 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件；

2、《景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；

4、《景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；

6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日